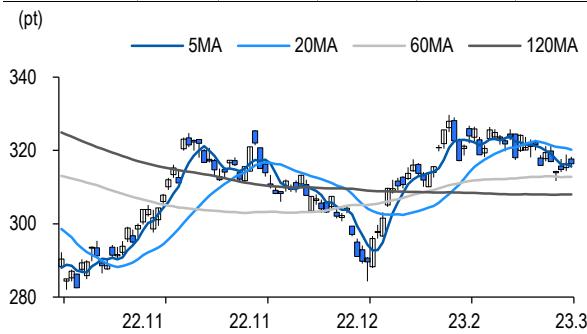


선물옵션시장 지표

2023.3.6

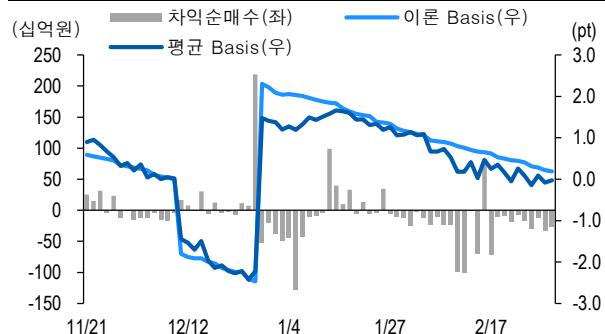
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.36	0.03	0.10	5,584.4	-
선물 3월물	316.80	0.48	1.50	18,371.5	314,143
선물 6월물	318.50	0.44	1.40	366.3	52,477
3월물(mini)	316.86	0.49	1.56	1,302.4	51,949
4월물(mini)	317.00	0.44	1.38	14.5	16,850



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.19	-0.03	0.44	-0.07%
베이시스(mini)	0.19	-0.03	0.50	-0.07%
제1스프레드(SP)	2.01	1.78	1.80	-0.07%
합성선물 베이시스(ATM)	0.19	0.45	0.45	0.08%



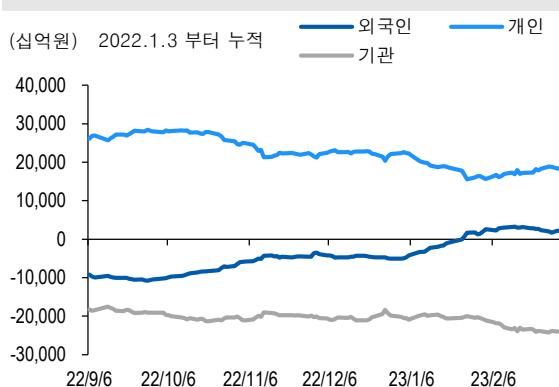
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-93.6	43.0	-50.6	0.1	-273.2	-167.1	33.5	0.9	5.2	19.1
개인	25.7	-23.3	2.4	0.0	3.8	-51.8	-20.4	0.2	-2.6	113.5
기관	33.5	-13.3	20.2	-27.1	-116.9	248.4	-12.9	0.6	-0.3	-135.2
금융투자	12.3	62.2	74.5	-6.6	-45.1	273.5	-14.4	1.6	0.4	-133.9
투신	24.4	-0.2	24.2	0.0	-10.4	-34.8	1.5	-0.5	0.0	9.2
은행+보험+기타금융	2.7	-130.4	-127.7	0.0	-5.2	7.1	0.0	-0.5	-0.6	0.1
연기금+국가지자체	-22.7	0.2	-22.5	-20.5	-40.8	2.7	0.0	0.0	0.0	-10.6
기타법인	34.5	-7.1	27.3	0.0	0.4	-29.5	-0.1	-1.7	-2.3	2.6

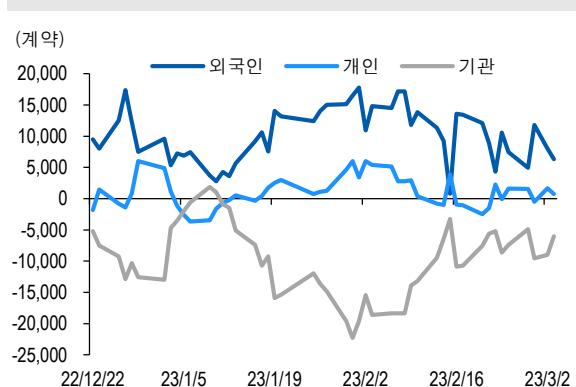
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,179,977	274.5	1,071,912	15.2%	지수옵션 전체	2,301,054	535.3	2,580,441
Put	1,121,077	260.8	1,508,529	15.8%	PCR(금액기준)	0.95	VKOSPI	17.69%(-0.62%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	325.0(K+3)	0.31	-0.02	222,189	40,849	3,930	14.8	320.0(K+1)
	322.5(K+2)	0.71	0.05	251,423	24,170	826	15.3	317.5(K+0)
	320.0(K+1)	1.38	0.14	196,282	28,396	1,726	15.7	315.0(K-1)
	317.5(K+0)	2.41	0.31	118,932	23,377	2,288	16.3	312.5(K-2)
	315.0(K-1)	3.77	0.49	33,487	17,784	3,373	16.7	310.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	320.0(K+1)	4.58	-1.30	7,628	15,084	7	14.3	320.0(K+1)
	317.5(K+0)	3.10	-1.14	47,678	15,816	-313	14.9	317.5(K+0)
	315.0(K-1)	1.97	-0.98	114,812	29,676	2,912	15.4	315.0(K-1)
	312.5(K-2)	1.17	-0.76	131,793	24,889	90	15.8	312.5(K-2)
	310.0(K-3)	0.65	-0.59	217,724	38,741	2,730	16.1	310.0(K-3)

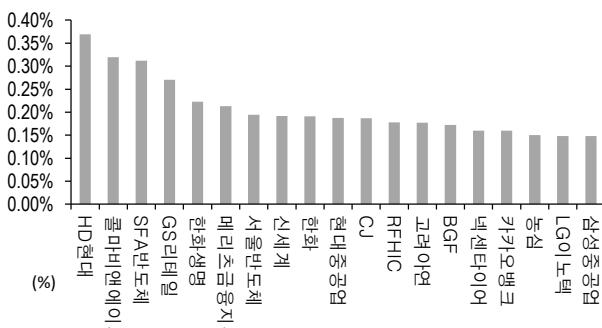
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,313,191	2,632.9	4,577,783	-5,355	-10,919	95,489	-81,966	19.1	113.5	-135.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	87,700	-0.34	143.7	73.4	140,728	-5,995	0.08%	2,914	4,312	-7,263
삼성전자	60,800	0.00	445.4	68.9	1,083,738	-101,312	0.04%	1,752	-1,686	-215
현대차	176,200	-1.23	64.2	66.3	26,382	-2,069	0.00%	-648	665	-52
넥센타이어	7,530	-1.95	0.4	65.9	11,299	223	0.16%	329	-2	-327
삼성전기	146,700	1.66	22.1	65.1	12,156	18	-0.06%	-349	1,131	-782
LG 전자	111,300	-0.36	32.4	61.5	45,195	1,252	0.08%	460	1,694	-2,264
LG 화학	705,000	4.29	90.7	56.7	8,665	1,395	0.00%	895	464	-1,359
아모레퍼시픽	145,500	1.18	12.4	56.4	11,584	-742	-0.08%	543	-408	-124
BGF	4,655	-0.32	0.3	56.3	8,619	-2,234	0.17%	-1,577	-270	1,847
RFHIC	23,000	2.91	2.1	55.7	12,958	407	0.18%	234	1,465	-1,699

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터